

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年6月27日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月21日	6月24日	6月25日	6月26日
加重平均金利	▲0.067	▲0.066	▲0.066	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.092	▲0.088	▲0.086
無コール残	91,345	93,555	99,155	94,762
ON	54,915	56,665	62,885	52,452
その他	36,430	36,890	36,270	42,310
有コール残	22,385	22,397	23,877	26,774

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

6月28日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	5月鉱工業生産指数[前月比]	+0.7%	21:30 (米)5月個人消費支出	0.4%
8:50	金融政策決定会合における主な意見(6月19・20日分)	-	21:30 (米)5月個人消費支出(PCE)価格コア指数[前年比]	1.6%
-	【記者会見】 若田部副総裁(6月27日)	-		

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.070	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.045	▲0.048	▲0.096
2W	▲0.070	▲0.025	▲0.055	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.103
1M	▲0.065	▲0.020	▲0.044	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.159

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.075%の合出から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.065%のレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

期末初物となるため、調達を控える先が多く、合出水準は低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 6月27日	日銀予想 6月28日	当社需給予想 7月1日
券	▲2,200	▲1,000	+1,000
財政	+4,600	+2,300	▲23,000
過不足	+2,400	+1,300	▲22,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,900		
共通担保(全店) CP等買入	▲800	▲2,800	+2,500
▲600			
当座預金増減	+9,500	+1,000	▲22,600
当座預金残高	4,110,700	4,111,700	4,089,100
準備預金残高	3,585,300	主な需給要因	
積み終了先	3,584,900		
超過準備	3,584,800		
非準備預金残高	525,400		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	40.0%		
乖離率	59.9%		

6月27日のオペ結果 [%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(6/27~6/28)						
	51,883	0	0			
	35,410	21	21	▲0.350	▲0.350	

国庫短期証券入札予定

6月28日	3ヶ月	第841回
7月5日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月12日	3ヶ月	
国債入札予定		
7月2日	10年	
7月4日	30年	
7月9日	5年	
7月17日	20年	

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	6月19日	0
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 21 26	6月26日	0
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 14 21 28	6月21日	1
10年超25年以下	1,000~3,000 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	400	7 19 28	6月19日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	6月26日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月14日	0

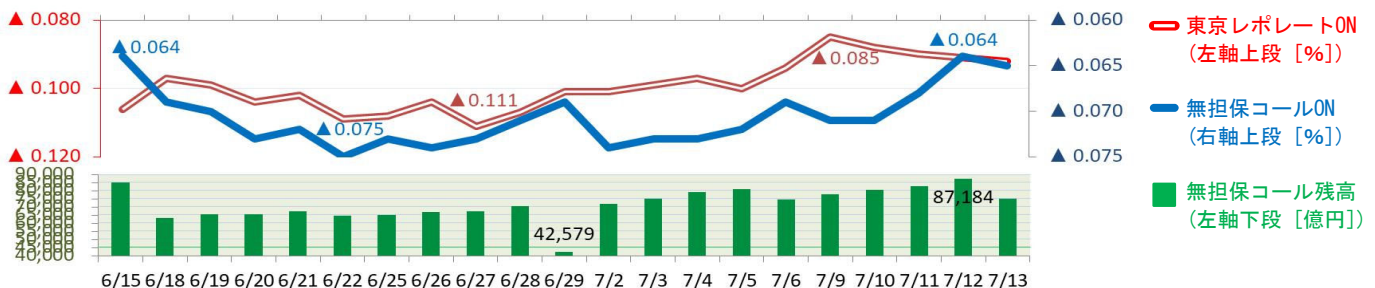
マナタリーベース [億円]
6月26日時点 5,223,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,090,600
6月28日以降の残り所要
積数 4,600
平均 300

1年前の市場推移

○2018年6月積み期 [6月15日~7月13日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会